



RELATÓRIO ANALÍTICO DOS INVESTIMENTOS
FPS – FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL

Publicação do resultado da Carteira de Investimento do Fundo de Previdência Social de Ji-Paraná no mês de **Maio de 2021**, disponibilizado pela Consultoria de Investimentos Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários LTDA, certificada pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, contratada pelo FPS através do Contrato nº 002/FPS/PMJP/2021.

Anderson Cleiton dos Santos Schmidt

Port. n. 006/FPS/PMJP/2021

Diretor de Contabilidade do FPS

Certificação ANBIMA – CPA 10

Agostinho Castello Branco Filho

Decreto n. 13.776/GAB/PM/JP/2021

Diretor-Presidente do FPS

Certificação APIMEC – CGRPPS n. 4873

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

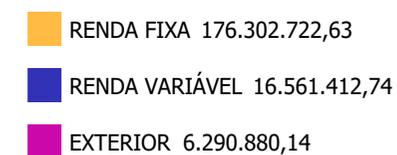
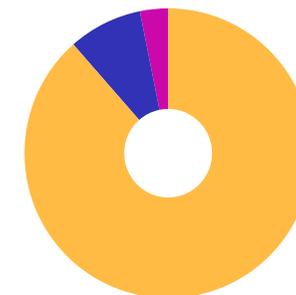
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 2.712.788,55 | 1,36% | 266 | 0,21% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 2.472.868,00 | 1,24% | 662 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 29.550,87 | 0,01% | 1.184 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 869.812,23 | 0,44% | 644 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 36.857.326,22 | 18,51% | 966 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 34.302.705,37 | 17,22% | 1.034 | 0,29% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 19.082.177,32 | 9,58% | 1.000 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 9.077.750,38 | 4,56% | 305 | 0,59% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 3.959.001,96 | 1,99% | 1.316 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 4.640.398,29 | 2,33% | 322 | 0,25% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 | Não há | 30.496.889,05 | 15,31% | 560 | 0,74% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 1.418.472,35 | 0,71% | 151 | 0,20% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 3.725,30 | 0,00% | 305 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 5.340.381,03 | 2,68% | 672 | 0,09% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES | D+0 | Não há | 46,34 | 0,00% | 222.617 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1800 | Não há | 25.038.829,37 | 12,57% | 18 | 15,08% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | D+15 | Não há | 2.091.476,42 | 1,05% | 98 | 0,37% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L... | D+15 | Não há | 2.888.431,89 | 1,45% | 122 | 0,23% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 3.169.160,77 | 1,59% | 14.217 | 0,16% | Artigo 8º, Inciso III |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | Não se ... | Não se aplica | 4.460.992,89 | 2,24% | 38 | 2,67% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | Não se ... | Não se aplica | 3.951.350,77 | 1,98% | | 3,12% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N... | D+12 | Não há | 2.419.087,55 | 1,21% | 1.078 | 1,44% | Artigo 9º - A, Inciso II |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 3.871.792,59 | 1,94% | 407 | 0,13% | Artigo 9º - A, Inciso III |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | D+0 | | 2,43 | 0,00% | | 0,00% | DF - Artigo 6º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 199.155.015,51 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 2,43 | | | | Artigo 6º |
| PL Total | | | 199.155.017,94 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 2021)

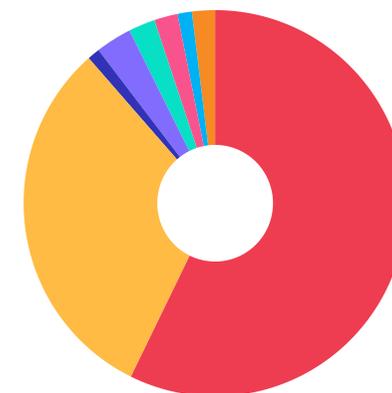
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2021 | | | GAP Superior |
|------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 114.004.379,19 | 57,24% | 10,60% | 53,01% | 66,26% | 17.955.734,09 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 62.298.343,44 | 31,28% | 4,06% | 20,32% | 40,00% | 17.363.662,76 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 176.302.722,63 | 88,53% | 14,66% | 73,33% | 106,26% | |



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2021)

| Artigos - Renda Variável | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2021 | | | GAP Superior |
|----------------------------------|---------------|----------------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00% | 2.091.476,42 | 1,05% | 3,69% | 18,45% | 20,00% | 37.739.526,68 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 6.057.592,66 | 3,04% | 3,07% | 3,07% | 10,00% | 13.857.908,89 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00% | 4.460.992,89 | 2,24% | 0,00% | 2,33% | 5,00% | 5.496.757,89 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00% | 3.951.350,77 | 1,98% | 0,00% | 2,20% | 5,00% | 6.006.400,01 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 16.561.412,74 | 8,32% | 6,76% | 26,05% | 40,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2021 | | | GAP Superior |
|---------------------------|---------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 10,00% | 2.419.087,55 | 1,21% | 0,00% | 0,31% | 5,00% | 7.538.663,23 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00% | 3.871.792,59 | 1,94% | 0,00% | 0,31% | 5,00% | 6.085.958,19 |
| Total Exterior | 10,00% | 6.290.880,14 | 3,16% | 0,00% | 0,62% | 10,00% | |



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Maio / 2021)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|----------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 129.121.933,78 | 64,83 | 0,02 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 36.581.908,70 | 18,37 | 0,00 |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 25.038.829,37 | 12,57 | 0,87 |
| ÍNDIGO DTVM | 4.460.992,89 | 2,24 | 2,65 |
| REDITUS INVESTIMENTOS | 3.951.350,77 | 1,98 | - |

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2021 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 114.004.379,19 | 57,24 | 10,60 | 66,26 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 62.298.343,44 | 31,28 | 4,06 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 2.091.476,42 | 1,05 | 18,45 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 6.057.592,66 | 3,04 | 3,07 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 4.460.992,89 | 2,24 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 3.951.350,77 | 1,98 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 2.419.087,55 | 1,21 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 3.871.792,59 | 1,94 | 0,00 | 5,00 |

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,88% | 2,19% | 2,53% | 3,96% | 8,47% | 18,26% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,84% | 1,85% | 2,25% | 3,53% | 7,95% | 16,84% | 1,07% | 0,02% |
| IRF-M 1+ (Benchmark) | 0,20% | -3,51% | -0,14% | -0,57% | -0,28% | 13,33% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,15% | -3,60% | -0,25% | -0,67% | -0,47% | 12,87% | 1,75% | 0,05% |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | 1,38% | -3,35% | 0,65% | 3,91% | 10,69% | 15,30% | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,35% | -3,38% | 0,62% | 3,85% | 10,29% | 14,80% | 3,75% | 0,13% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,39% | -3,40% | 0,63% | 3,91% | 10,54% | 14,65% | 3,76% | 0,13% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,20% | 0,60% | 0,52% | 0,91% | 2,11% | 8,57% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,18% | 0,47% | 0,44% | 0,79% | 1,73% | 7,88% | 0,14% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,17% | 0,51% | 0,46% | 0,79% | 1,89% | 8,12% | 0,14% | 0,00% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,69% | 1,42% | 1,92% | 3,27% | 7,39% | 17,55% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,67% | 1,31% | 1,85% | 3,15% | 7,10% | 16,90% | 1,01% | 0,02% |
| IMA-B (Benchmark) | 1,06% | -1,14% | 1,25% | 3,66% | 9,17% | 16,46% | - | - |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,06% | -1,19% | 1,22% | 3,59% | 8,90% | 15,96% | 2,40% | 0,08% |

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| IRF-M (Benchmark) | 0,20% | -1,79% | 0,19% | 0,13% | 0,71% | 12,10% | - | - |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,16% | -1,87% | 0,11% | 0,06% | 0,51% | 11,56% | 1,19% | 0,03% |
| CDI (Benchmark) | 0,27% | 0,97% | 0,68% | 1,13% | 2,18% | 7,16% | - | - |
| CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,12% | 0,26% | 0,24% | 0,27% | 0,41% | 3,20% | 0,01% | 0,00% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,28% | 0,78% | 0,56% | 1,05% | 1,85% | 6,91% | 0,03% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,24% | 0,85% | 0,61% | 1,21% | 2,14% | 6,48% | 0,05% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | 0,83% | 3,22% | 2,08% | 4,61% | 8,06% | 10,08% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,60% | -0,44% | 0,96% | 2,25% | 4,15% | - | 1,19% | 0,04% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,24% | 0,72% | 1,21% | 2,05% | 3,45% | 15,85% | 1,14% | 0,02% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 0,20% | 0,62% | 0,46% | 0,71% | 1,32% | 5,38% | 0,01% | 0,00% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -2,70% | -2,53% | -2,34% | -6,38% | -15,44% | -34,26% | 4,71% | 0,06% |

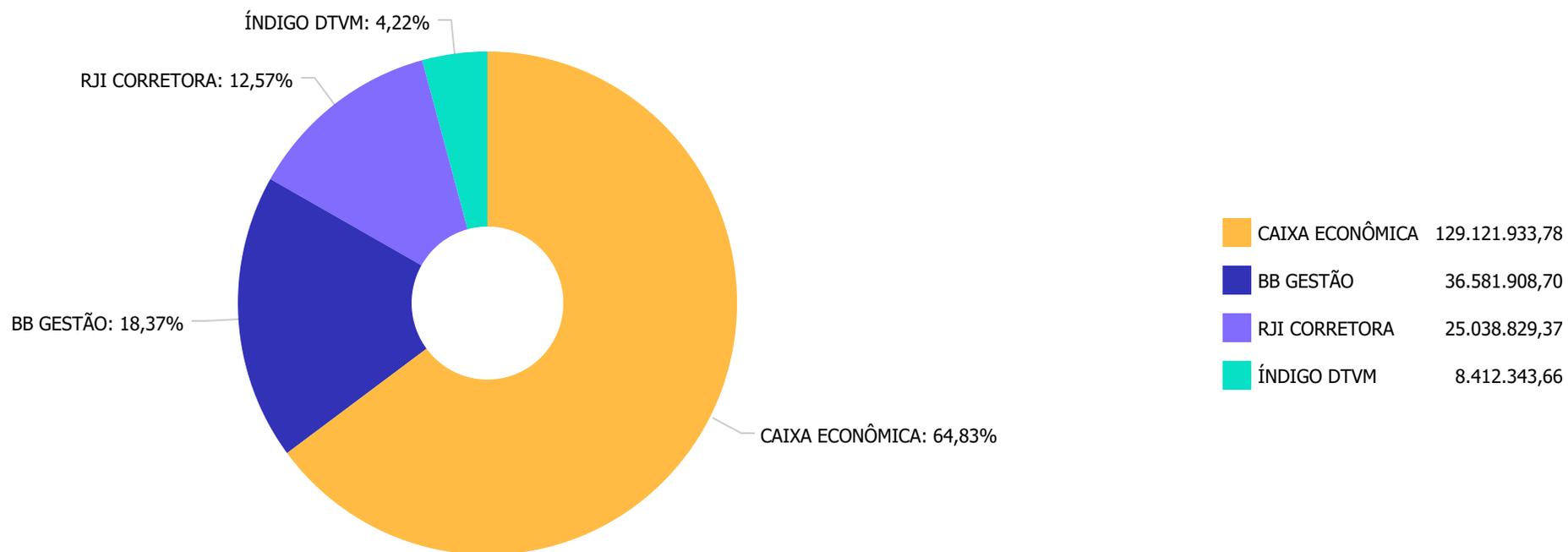
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark) | 1,52% | 6,68% | 4,22% | 8,90% | 17,20% | 29,51% | - | - |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | 0,00% | 4,69% | - | 4,66% | - | - | - | - |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 1,37% | 3,36% | 3,55% | 4,69% | 10,72% | - | 1,31% | 0,05% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 0,48% | 13,08% | 10,17% | 16,63% | 36,09% | 49,57% | 7,04% | 0,15% |
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 6,38% | 20,97% | 25,45% | 28,81% | 56,49% | - | 7,57% | 0,19% |

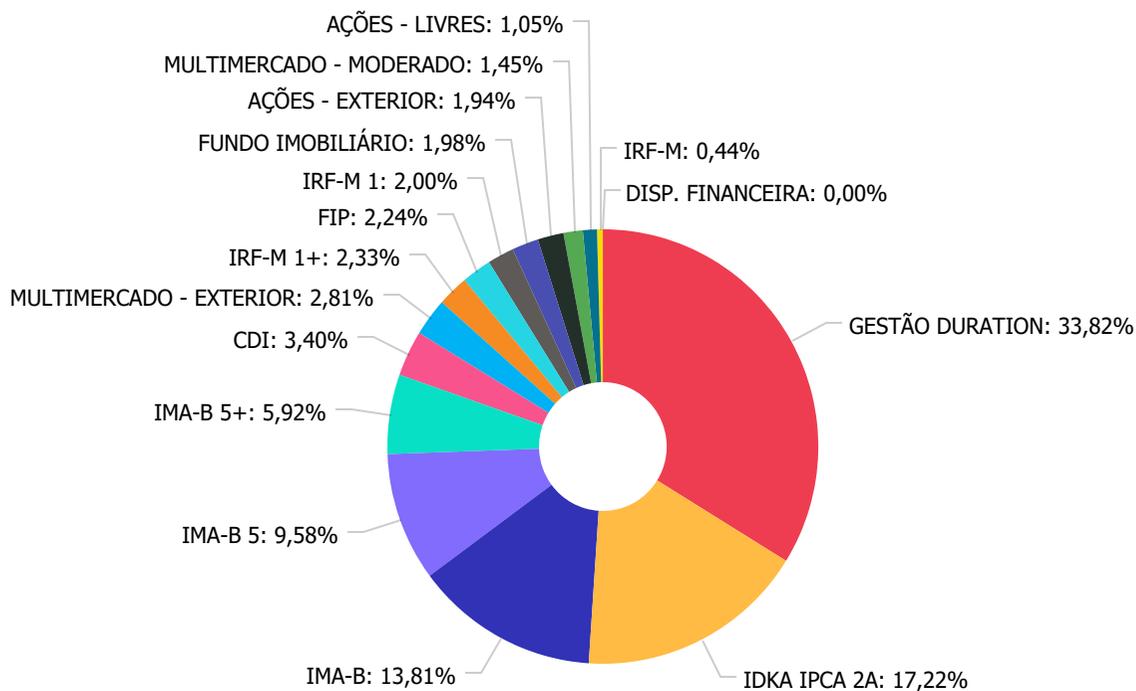
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|-------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -3,79% | 9,66% | 0,11% | 10,42% | 33,33% | 105,13% | 5,87% | 0,17% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU... | -4,81% | 2,82% | -4,47% | 4,31% | - | - | 8,80% | - |

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Maio / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2021)

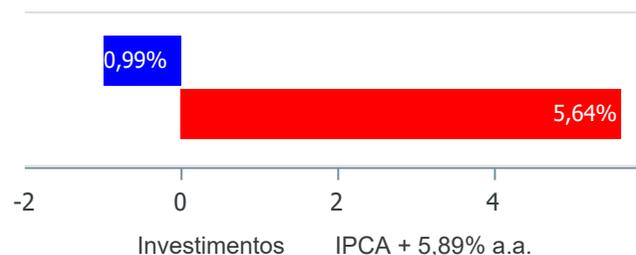


| | |
|-------------------------|---------------|
| GESTÃO DURATION | 67.354.215,27 |
| IDKA IPCA 2A | 34.302.705,37 |
| IMA-B | 27.511.697,37 |
| IMA-B 5 | 19.082.177,32 |
| IMA-B 5+ | 11.790.538,93 |
| CDI | 6.762.625,02 |
| MULTIMERCADO - EXTERIOR | 5.588.248,32 |
| IRF-M 1+ | 4.640.398,29 |
| FIP | 4.460.992,89 |
| IRF-M 1 | 3.988.552,83 |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 3.951.350,77 |
| AÇÕES - EXTERIOR | 3.871.792,59 |
| MULTIMERCADO - MODERADO | 2.888.431,89 |
| AÇÕES - LIVRES | 2.091.476,42 |
| IRF-M | 869.812,23 |
| DISP. FINANCEIRA | 2,43 |

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 196.621.059,54 | 225.232,77 | 793.807,25 | 195.075.703,07 | -976.781,99 | -976.781,99 | -0,50% | -0,50% | 0,71% | 0,71% | -70,33% | 1,84% |
| Fevereiro | 195.075.703,07 | 2.899.696,77 | 1.613.708,56 | 194.460.140,17 | -1.901.551,11 | -2.878.333,10 | -0,97% | -1,46% | 1,27% | 1,99% | -73,44% | 1,68% |
| Março | 194.460.140,17 | 51.155.593,18 | 50.201.642,13 | 195.074.848,95 | -339.242,27 | -3.217.575,37 | -0,17% | -1,63% | 1,46% | 3,48% | -46,93% | 2,36% |
| Abril | 195.074.848,95 | 2.685.560,90 | 1.733.139,02 | 197.277.761,37 | 1.250.490,54 | -1.967.084,83 | 0,64% | -1,00% | 0,77% | 4,27% | -23,51% | 1,70% |
| Maio | 197.277.761,37 | 5.003.421,99 | 3.148.124,73 | 199.155.015,51 | 21.956,88 | -1.945.127,95 | 0,01% | -0,99% | 1,31% | 5,64% | -17,61% | 2,05% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



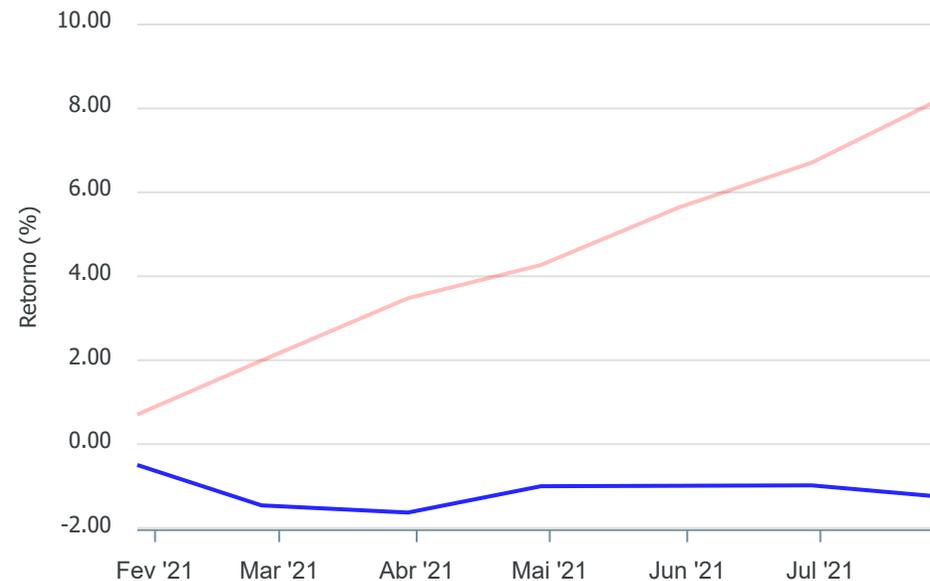
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 8.953.190,24 | 0,00 | 0,00 | 9.077.750,38 | 124.560,14 | 1,39% | 1,39% | 3,76% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 2.676.563,69 | 0,00 | 0,00 | 2.712.788,55 | 36.224,86 | 1,35% | 1,35% | 3,75% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 2.447.057,97 | 0,00 | 0,00 | 2.472.868,00 | 25.810,03 | 1,05% | 1,05% | 2,40% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 34.015.712,51 | 0,00 | 0,00 | 34.302.705,37 | 286.992,86 | 0,84% | 0,84% | 1,07% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 18.955.293,60 | 0,00 | 0,00 | 19.082.177,32 | 126.883,72 | 0,67% | 0,67% | 1,01% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 30.314.587,53 | 0,00 | 0,00 | 30.496.889,05 | 182.301,52 | 0,60% | 0,60% | 1,19% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 5.327.407,98 | 0,00 | 0,00 | 5.340.381,03 | 12.973,05 | 0,24% | 0,24% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 36.769.561,29 | 0,00 | 0,00 | 36.857.326,22 | 87.764,93 | 0,24% | 0,24% | 1,14% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.545.723,67 | 369.000,00 | 500.000,00 | 1.418.472,35 | 3.748,68 | 0,20% | 0,28% | 0,03% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 29.498,41 | 0,00 | 0,00 | 29.550,87 | 52,46 | 0,18% | 0,18% | 0,14% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.988.255,73 | 0,00 | 36.000,00 | 3.959.001,96 | 6.746,23 | 0,17% | 0,17% | 0,14% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 868.432,08 | 0,00 | 0,00 | 869.812,23 | 1.380,15 | 0,16% | 0,16% | 1,19% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 4.633.597,86 | 0,00 | 0,00 | 4.640.398,29 | 6.800,43 | 0,15% | 0,15% | 1,75% |
| CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES | 46,28 | 0,00 | 0,00 | 46,34 | 0,06 | 0,13% | 0,12% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 22.079,29 | 2.593.219,99 | 2.612.124,73 | 3.725,30 | 550,75 | 0,02% | 0,20% | 0,01% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 25.733.716,46 | 0,00 | 0,00 | 25.038.829,37 | -694.887,09 | -2,70% | -2,70% | 4,71% |
| Total Renda Fixa | 176.280.724,59 | 2.962.219,99 | 3.148.124,73 | 176.302.722,63 | 207.902,78 | 0,12% | | 1,77% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Maio/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|-------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 0,00 | 2.041.202,00 | 0,00 | 2.091.476,42 | 50.274,42 | 2,46% | 6,38% | 7,57% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 2.849.345,75 | 0,00 | 0,00 | 2.888.431,89 | 39.086,14 | 1,37% | 1,37% | 1,31% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 3.153.999,77 | 0,00 | 0,00 | 3.169.160,77 | 15.161,00 | 0,48% | 0,48% | 7,04% |
| CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11 | 4.460.794,04 | 0,00 | 0,00 | 4.460.992,89 | 198,85 | 0,00% | - | - |
| AQ3 RENDA FII - ARFI11B | 3.967.041,96 | 0,00 | 0,00 | 3.951.350,77 | -15.691,19 | -0,40% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Variável | 14.431.181,52 | 2.041.202,00 | 0,00 | 16.561.412,74 | 89.029,22 | 0,54% | | 3,46% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Maio / 2021)**FUNDOS EXTERIOR**

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|-------------------|-----------------|---------------------|----------------------|--------------------|-------------------|------------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4.024.493,42 | 0,00 | 0,00 | 3.871.792,59 | -152.700,83 | -3,79% | -3,79% | 5,87% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ... | 2.541.361,84 | 0,00 | 0,00 | 2.419.087,55 | -122.274,29 | -4,81% | -4,81% | 8,80% |
| Total Exterior | 6.565.855,26 | 0,00 | 0,00 | 6.290.880,14 | -274.975,12 | -4,19% | | 7,00% |

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.